

# マニュライフ・ カナダ債券ファンド 愛称：メープルギフト

## ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券	
信託期間	2012年9月7日から無期限です。	
運用方針	主として「マニュライフ・カナダ債券マザーファンド」受益証券を通じて、実質的にカナダドル建ての公社債および短期金融商品等に投資することにより、安定した金利収益の確保および中長期的な値上り益の獲得をめざして運用を行います。	
主な投資対象	ベビーフンド	「マニュライフ・カナダ債券マザーファンド」（以下、「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。 ・投資にあたっては、実質的にカナダドル建ての社債を中心に投資を行います。 ・実質投資対象の格付は、取得時において投資適格（スタンダード&プアーズ社でBBB-以上、ムーディーズ社でBaa3以上またはそれらと同等）とすることを基本とします。
	マザーファンド	主にカナダドル建ての公社債を投資対象とします。
マザーファンドの運用方法	マニュライフ・インベストメント・マネジメント・リミテッドに運用指図に関する権限（国内の短期金融資産の運用の指図に関する権限を除きます。）の一部を委託します。	
主な投資制限	ベビーフンド	①債券への実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	マザーファンド	①債券への投資割合には、制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時（原則毎月20日。ただし、休業日の場合は翌営業日とします。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②基準価額の水準等を勘案して分配するものとします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

## 運用報告書（全体版）

第133期（決算日	2023年9月20日）
第134期（決算日	2023年10月20日）
第135期（決算日	2023年11月20日）
第136期（決算日	2023年12月20日）
第137期（決算日	2024年1月22日）
第138期（決算日	2024年2月20日）

### －受益者のみなさまへ－

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。  
さて、「マニュライフ・カナダ債券ファンド（愛称：メープルギフト）」は、このたび、第138期の決算を行いました。  
ここに、第133期～第138期の運用状況をご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## マニュライフ・インベストメント・マネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-1 丸の内トラストタワーN館

お問い合わせ先

サポートダイヤル：03-6267-1901

受付時間：営業日の午前9時～午後5時

ホームページアドレス：www.manulifeim.co.jp/

## ■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			参考指数		債券組入比率	純資産額
		(分配落)	税金 分配	込 金	期 騰	落 率		
第19作成期	109期 (2021年9月21日)	円	円	%		%	%	百万円
	110期 (2021年10月20日)	7,891	15	△0.4	15,394	△0.3	96.2	2,337
	111期 (2021年11月22日)	8,385	15	6.5	16,425	6.7	96.3	2,407
	112期 (2021年12月20日)	8,113	15	△3.1	15,936	△3.0	97.5	2,193
	113期 (2022年1月20日)	8,051	15	△0.6	15,853	△0.5	97.1	2,158
	114期 (2022年2月21日)	8,101	15	0.8	15,982	0.8	92.0	2,131
第20作成期	115期 (2022年2月21日)	7,879	15	△2.6	15,573	△2.6	90.5	2,067
	116期 (2022年3月22日)	8,050	15	2.4	15,960	2.5	89.7	2,125
	117期 (2022年4月20日)	8,475	15	5.5	16,822	5.4	96.4	2,186
	118期 (2022年5月20日)	8,115	15	△4.1	16,166	△3.9	95.0	2,072
	119期 (2022年6月20日)	8,228	15	1.6	16,442	1.7	95.7	2,066
	120期 (2022年7月20日)	8,613	15	4.9	17,297	5.2	97.6	2,115
第21作成期	121期 (2022年8月22日)	8,536	15	△0.7	17,199	△0.6	98.4	2,082
	122期 (2022年9月20日)	8,659	15	1.6	17,479	1.6	96.1	2,074
	123期 (2022年10月20日)	8,406	15	△2.7	17,061	△2.4	98.0	1,969
	124期 (2022年11月21日)	8,266	15	△1.5	16,829	△1.4	97.3	1,930
	125期 (2022年12月20日)	7,981	15	△3.3	16,275	△3.3	94.3	1,854
	126期 (2023年1月20日)	7,831	15	△1.7	16,001	△1.7	96.6	1,826
第22作成期	127期 (2023年2月20日)	7,985	15	2.2	16,360	2.2	97.1	1,863
	128期 (2023年3月20日)	7,911	15	△0.7	16,232	△0.8	97.2	1,846
	129期 (2023年4月20日)	8,063	15	2.1	16,660	2.6	97.2	1,870
	130期 (2023年5月22日)	8,208	15	2.0	17,006	2.1	97.8	1,890
	131期 (2023年6月20日)	8,557	15	4.4	17,815	4.8	96.7	1,953
	132期 (2023年7月20日)	8,477	15	△0.8	17,690	△0.7	96.1	1,904
第23作成期	133期 (2023年8月21日)	8,408	15	△0.6	17,638	△0.3	97.6	1,819
	134期 (2023年9月20日)	8,559	15	2.0	18,009	2.1	96.6	1,826
	135期 (2023年10月20日)	8,372	15	△2.0	17,720	△1.6	97.7	1,749
	136期 (2023年11月20日)	8,640	15	3.4	18,296	3.2	97.6	1,785
	137期 (2023年12月20日)	8,959	15	3.9	18,903	3.3	97.3	1,801
	138期 (2024年1月22日)	8,962	15	0.2	18,984	0.4	97.4	1,767
	138期 (2024年2月20日)	9,100	15	1.7	19,272	1.5	98.1	1,777

(注1) 基準価額は1万円当たり、騰落率は分配金込みで表示しています。

(注2) 当ファンドの参考指数は、FTSE/TMXカナダ・オール・コーポレート・ボンド・インデックス（円換算ベース/三菱UFJ銀行T T M）です。（2014年4月以降、DEXユニバース・オール・コーポレート・ボンド・インデックスより名称変更となりました。以下、同じ。）当参考指数は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

※参考指数に関して

FTSE/TMXカナダ・オール・コーポレート・ボンド・インデックスとは、FTSE/TMXが開発した、カナダの投資適格社債の価格動向を示す指数です。

## ■当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数	騰 落 率	債 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率			
第133期	(期 首) 2023年 8月21日	円 8,408	% -	17,638	% -	% 97.6
	8月末	8,533	1.5	17,898	1.5	97.7
	(期 末) 2023年 9月20日	8,574	2.0	18,009	2.1	96.6
第134期	(期 首) 2023年 9月20日	8,559	-	18,009	-	96.6
	9月末	8,530	△0.3	17,999	△0.1	96.8
	(期 末) 2023年10月20日	8,387	△2.0	17,720	△1.6	97.7
第135期	(期 首) 2023年10月20日	8,372	-	17,720	-	97.7
	10月末	8,375	0.0	17,695	△0.1	96.3
	(期 末) 2023年11月20日	8,655	3.4	18,296	3.2	97.6
第136期	(期 首) 2023年11月20日	8,640	-	18,296	-	97.6
	11月末	8,696	0.6	18,398	0.6	97.1
	(期 末) 2023年12月20日	8,974	3.9	18,903	3.3	97.3
第137期	(期 首) 2023年12月20日	8,959	-	18,903	-	97.3
	12月末	8,912	△0.5	18,797	△0.6	98.0
	(期 末) 2024年 1月22日	8,977	0.2	18,984	0.4	97.4
第138期	(期 首) 2024年 1月22日	8,962	-	18,984	-	97.4
	1月末	9,024	0.7	19,114	0.7	99.0
	(期 末) 2024年 2月20日	9,115	1.7	19,272	1.5	98.1

(注1) 騰落率は期首比です。(期末基準価額は分配金を含みます。)

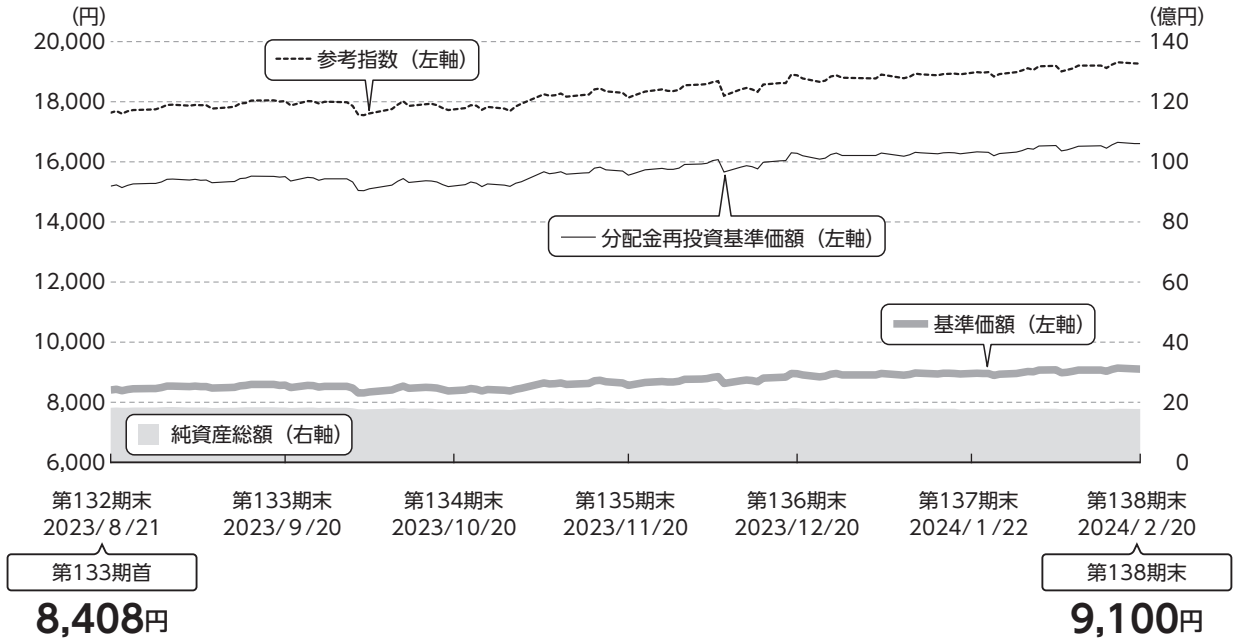
(注2) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドの参考指数は、FTSE/TMXカナダ・オール・コーポレート・ボンド・インデックス(円換算ベース/三菱UFJ銀行T T M)です。当参考指数は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

## 運用経過

### 基準価額等の推移 (2023年8月22日から2024年2月20日まで)



※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資(複利運用)したもとして、委託会社が算出したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※当ファンドの参考指数は、FTSE/TMXカナダ・オール・コーポレート・ボンド・インデックス(円換算ベース/三菱UFJ銀行T T M)です。当参考指数は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

※分配金を再投資するかどうかについては、お客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益状況を示すものではありません。

既払分配金	90円
騰落率 (分配金再投資ベース)	9.3%

---

## 基準価額の主な変動要因

### 上昇要因

---

- ・ 安定的な利息収入がプラスに寄与しました。
- ・ カナダ長期国債利回りの低下がプラスに寄与しました。
- ・ カナダドルが対円で上昇（円安）したことがプラスに寄与しました。

## 投資環境

### カナダ債券市況

期初3.7%台であったカナダ長期国債利回りは、米国長期金利の動きと連動する形で、10月頃まで上昇傾向となりました。その後12月末にかけては、F R B（米連邦準備制度理事会）が2024年に利下げに転じるとの見方が広がり米国長期金利が低下したことから、カナダ長期国債利回りも低下傾向となりました。しかし2024年に入り、米国金融当局者が早期利下げ観測に対するけん制の動きを見せ、米国長期金利が上昇したことから、カナダ長期国債利回りも上昇し、3.5%台で期を終えました。

カナダ社債は、カナダ長期金利の低下や安定的な利息収入がプラス寄与し、期を通じて上昇しました（トータル・リターン・ベース）。

### 為替市況

外国為替市場では、カナダドルは対円で上昇（円安）しました。期初に107円台で始まった後、9月末頃にかけては、カナダ長期金利が上昇する中、円安カナダドル高が進行しました。その後はレンジ内で推移しましたが、11月後半から12月中旬にかけては、カナダ長期金利の低下を受けて、一時円高カナダドル安傾向となりました。しかし2024年に入り、米国長期金利と連動する形でカナダ長期金利が上昇したことに加え、日本銀行（中央銀行）による政策修正観測の後退が日本長期金利に対する低下圧力につながったことなどから、円安カナダドル高が進行し、111円台で期を終えました。

## 当該投資信託のポートフォリオ

### 当ファンド

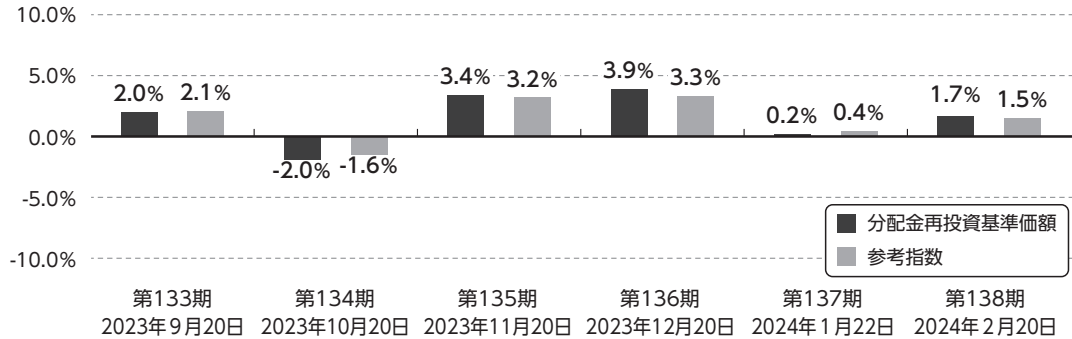
主要投資対象とする「マニユライフ・カナダ債券マザーファンド」受益証券の組入比率は高位に維持しました。

### マニユライフ・カナダ債券マザーファンド

安定した金利収入の確保と中長期的な値上り益の獲得をめざして、主にカナダドル建ての公社債に投資を行いました。

## 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※当ファンドの参考指数は、FTSE/TMXカナダ・オール・コーポレート・ボンド・インデックス（円換算ベース／三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

## 収益分配金について

当作成期間の収益分配は、分配方針に基づき第133期～第138期15円、合計90円とさせていただきます。留保益の運用については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。

### [分配原資の内訳]

(1万口当たり、税引前)

	第133期	第134期	第135期	第136期	第137期	第138期
	自 2023年8月22日 至 2023年9月20日	自 2023年9月21日 至 2023年10月20日	自 2023年10月21日 至 2023年11月20日	自 2023年11月21日 至 2023年12月20日	自 2023年12月21日 至 2024年1月22日	自 2024年1月23日 至 2024年2月20日
当期分配金 (円)	15	15	15	15	15	15
(対基準価額比率) (%)	0.175	0.179	0.173	0.167	0.167	0.165
当期の収益 (円)	14	14	14	14	11	14
当期の収益以外 (円)	0	0	0	0	3	0
翌期繰越分配対象額 (円)	503	510	528	732	741	872

(注1) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注3) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。



## 今後の運用方針

### 当ファンド

主要投資対象とする「マニユライフ・カナダ債券マザーファンド」受益証券の組入比率を高位に保ち、安定した金利収入の確保と中長期的な値上り益の獲得をめざして運用を行う方針です。

### マニユライフ・カナダ債券マザーファンド

カナダ社債市場については、今後も堅調に推移するとの見通しに変わりはありません。カナ

ダ企業は総じて健全な財務体質を有しており、相対的に高い利回りを求める投資家の需要もカナダ社債市場を後押しすると考えられます。当ファンドでは引き続き、銘柄選択と業種分散に重点を置き、安定的で質が高いと考えられる企業の中から利回りが高い債券を選択して投資を行います。投資対象の格付けは、取得時において投資適格（スタンダード&プアーズ社でBBB-以上、ムーディーズ社でBaa3以上またはそれらと同等）とすることを基本とします。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第133期～第138期 (2023年8月22日～2024年2月20日)		項目の概要
	金額	比率	
	平均基準価額	8,678円	
(a) 信託報酬	64円	0.737%	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(31)	(0.358)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(31)	(0.357)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	( 2)	(0.022)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用	11	0.128	(e) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（保管費用）	( 3)	(0.036)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	( 3)	(0.034)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（印刷）	( 5)	(0.058)	印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用
（その他）	( 0)	(0.001)	その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	75	0.865	

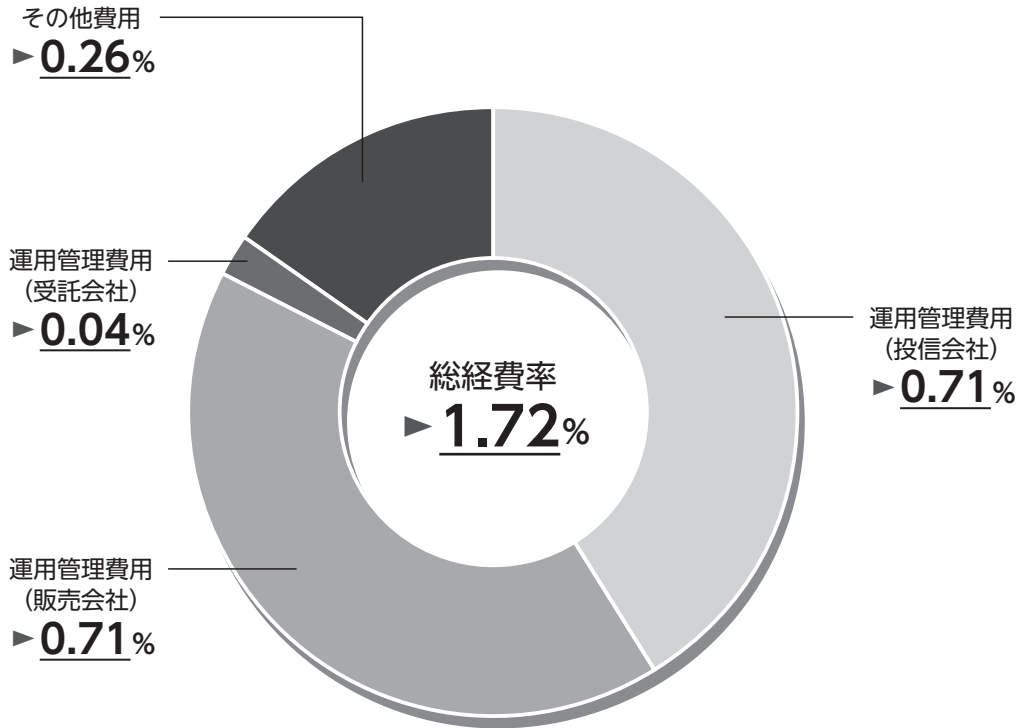
\* 作成期間の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

\* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

\* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

\* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報) 総経費率



\*各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

\*各比率は、年率換算した値です。

\*上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.72%**です。

■**売買及び取引の状況**（2023年8月22日から2024年2月20日まで）  
**親投資信託受益証券の設定、解約状況**

	第133期～第138期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
マニュアルフ・カナダ債券マザーファンド	10,021	18,958	125,081	235,213

(注) 単位未満は切り捨てております。

■**利害関係人との取引状況等**（2023年8月22日から2024年2月20日まで）  
**期中の利害関係人との取引状況**  
**当ファンド**

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

**マニュアルフ・カナダ債券マザーファンド**

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■**第一種金融商品取引業又は第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己取引状況**  
（2023年8月22日から2024年2月20日まで）

該当事項はありません。

■**自社による当ファンドの設定・解約状況**（2023年8月22日から2024年2月20日まで）  
該当事項はありません。

■**組入資産の明細**（2024年2月20日現在）  
**親投資信託残高**

項 目	第22作成期末		第23作成期末	
	口 数	口 数	評 価 額	評 価 額
	千口	千口	千円	千円
マニュアルフ・カナダ債券マザーファンド	1,010,405	895,344	1,777,707	

(注1) マザーファンドの2024年2月20日現在の受益権総口数は895,344千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てております。

■**有価証券の貸付及び借入の状況**（2024年2月20日現在）  
該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2024年2月20日現在)

項 目	第 23 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
マニュアルフ・カナダ債券マザーファンド	千円 1,777,707	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等、 そ の 他	5,594	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	1,783,301	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨てております。

(注2) マニュアルフ・カナダ債券マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(1,752,600千円)の投資信託財産総額(1,809,429千円)に対する比率は96.9%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当作成期末における邦貨換算レートは、1カナダドル=111.38円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第133期末 2023年9月20日	第134期末 2023年10月20日	第135期末 2023年11月20日	第136期末 2023年12月20日	第137期末 2024年1月22日	第138期末 2024年2月20日
<b>(A) 資 産</b>	<b>1,831,947,986円</b>	<b>1,757,188,936円</b>	<b>1,794,608,416円</b>	<b>1,815,026,768円</b>	<b>1,787,307,178円</b>	<b>1,783,301,791円</b>
マニュアルフ・カナダ債券マザーファンド(評価額)	1,826,207,204	1,749,290,183	1,785,032,111	1,801,833,831	1,767,220,689	1,777,707,340
未 収 入 金	5,740,782	7,898,753	9,576,305	13,192,937	20,086,489	5,594,451
<b>(B) 負 債</b>	<b>5,740,782</b>	<b>7,898,753</b>	<b>9,576,305</b>	<b>13,192,937</b>	<b>20,086,489</b>	<b>5,594,451</b>
未払収益分配金	3,200,656	3,134,318	3,099,084	3,016,662	2,957,759	2,930,443
未 払 解 約 金	66,182	2,325,714	3,985,235	7,758,187	14,465,057	332,956
未 払 信 託 報 酬	2,205,744	2,170,521	2,214,846	2,149,888	2,368,653	2,071,792
その他未払費用	268,200	268,200	277,140	268,200	295,020	259,260
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>1,826,207,204</b>	<b>1,749,290,183</b>	<b>1,785,032,111</b>	<b>1,801,833,831</b>	<b>1,767,220,689</b>	<b>1,777,707,340</b>
元 本	2,133,771,033	2,089,545,663	2,066,056,002	2,011,108,451	1,971,839,626	1,953,628,706
次期繰越損益金	△ 307,563,829	△ 340,255,480	△ 281,023,891	△ 209,274,620	△ 204,618,937	△ 175,921,366
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>2,133,771,033口</b>	<b>2,089,545,663口</b>	<b>2,066,056,002口</b>	<b>2,011,108,451口</b>	<b>1,971,839,626口</b>	<b>1,953,628,706口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	8,559円	8,372円	8,640円	8,959円	8,962円	9,100円

(注1) 当ファンドの第133期首元本額は2,164,262,175円、第133~138期中追加設定元本額は21,666,872円、第133~138期中一部解約元本額は232,300,341円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第133期0.8559円、第134期0.8372円、第135期0.8640円、第136期0.8959円、第137期0.8962円、第138期0.9100円です。

(注3) 貸借対照表上の純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は、第133期末307,563,829円、第134期末340,255,480円、第135期末281,023,891円、第136期末209,274,620円、第137期末204,618,937円、第138期末175,921,366円です。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

## ■損益の状況

項 目	第133期	第134期	第135期	第136期	第137期	第138期
	自 2023年8月22日 至 2023年9月20日	自 2023年9月21日 至 2023年10月20日	自 2023年10月21日 至 2023年11月20日	自 2023年11月21日 至 2023年12月20日	自 2023年12月21日 至 2024年1月22日	自 2024年1月23日 至 2024年2月20日
(A) 有価証券売買損益	37,765,043円	△ 33,475,900円	60,980,241円	69,697,482円	6,192,756円	32,056,473円
売 買 益	38,282,800	384,894	61,672,691	70,638,866	6,979,854	32,642,084
売 買 損	△ 517,757	△ 33,860,794	△ 692,450	△ 941,384	△ 787,098	△ 585,611
(B) 信託報酬等	△ 2,473,944	△ 2,438,721	△ 2,491,986	△ 2,418,088	△ 2,663,673	△ 2,331,052
(C) 当期損益金(A+B)	35,291,099	△ 35,914,621	58,488,255	67,279,394	3,529,083	29,725,421
(D) 前期繰越損益金	38,428,999	69,082,168	29,826,460	82,960,721	143,871,074	143,556,937
(E) 追加信託差損益金	△378,083,271	△370,288,709	△366,239,522	△356,498,073	△349,061,335	△346,273,281
(配当等相当額)	( 130,017)	( 161,517)	( 115,665)	( 133,515)	( 612,662)	( 179,371)
(売買損益相当額)	(△378,213,288)	(△370,450,226)	(△366,355,187)	(△356,631,588)	(△349,673,997)	(△346,452,652)
(F) 計 (C+D+E)	△304,363,173	△337,121,162	△277,924,807	△206,257,958	△201,661,178	△172,990,923
(G) 収益分配金	△ 3,200,656	△ 3,134,318	△ 3,099,084	△ 3,016,662	△ 2,957,759	△ 2,930,443
次期繰越損益金(F+G)	△307,563,829	△340,255,480	△281,023,891	△209,274,620	△204,618,937	△175,921,366
追加信託差損益金	△378,215,565	△370,453,783	△366,358,552	△356,635,753	△349,693,759	△346,456,721
(配当等相当額)	( 1,398)	( 1,340)	( -)	( -)	( -)	( -)
(売買損益相当額)	(△378,216,963)	(△370,455,123)	(△366,358,552)	(△356,635,753)	(△349,693,759)	(△346,456,721)
分配準備積立金	107,536,739	106,671,537	109,095,465	147,361,133	146,149,057	170,535,355
繰越損益金	△ 36,885,003	△ 76,473,234	△ 23,760,804	-	△ 1,074,235	-

(注1) 損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(B)信託報酬には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) マザーファンドの投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、マザーファンドの純資産総額に対して年率0.29%以内の額を委託者報酬の中から支弁しております。

(注5) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。

第133期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (6,474,514円)、費用控除後の有価証券等損益額 (0円)、信託約款に規定する収益調整金 (133,692円) および分配準備積立金 (104,130,587円) より分配対象収益は110,738,793円 (10,000口当たり518円) であり、うち3,200,656円 (10,000口当たり15円) を分配金額としております。

第134期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (4,493,030円)、費用控除後の有価証券等損益額 (0円)、信託約款に規定する収益調整金 (166,414円) および分配準備積立金 (105,147,751円) より分配対象収益は109,807,195円 (10,000口当たり525円) であり、うち3,134,318円 (10,000口当たり15円) を分配金額としております。

第135期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (6,462,172円)、費用控除後の有価証券等損益額 (0円)、信託約款に規定する収益調整金 (119,030円) および分配準備積立金 (105,358,047円) より分配対象収益は112,194,549円 (10,000口当たり543円) であり、うち3,099,084円 (10,000口当たり15円) を分配金額としております。

第136期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (6,036,477円)、費用控除後の有価証券等損益額 (37,717,426円)、信託約款に規定する収益調整金 (137,680円) および分配準備積立金 (106,060,517円) より分配対象収益は150,377,795円 (10,000口当たり747円) であり、うち3,016,662円 (10,000口当たり15円) を分配金額としております。

第137期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (4,603,318円)、費用控除後の有価証券等損益額 (0円)、信託約款に規定する収益調整金 (632,424円) および分配準備積立金 (143,871,074円) より分配対象収益は149,106,816円 (10,000口当たり756円) であり、うち2,957,759円 (10,000口当たり15円) を分配金額としております。

第138期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (6,036,477円)、費用控除後の有価証券等損益額 (22,625,948円)、信託約款に規定する収益調整金 (183,440円) および分配準備積立金 (144,619,933円) より分配対象収益は173,465,798円 (10,000口当たり887円) であり、うち2,930,443円 (10,000口当たり15円) を分配金額としております。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

## ■分配金のお知らせ

決算期	第133期	第134期	第135期	第136期	第137期	第138期
1万口当たり分配金	15円	15円	15円	15円	15円	15円

- ・分配金は税込みです。
- ・分配金を再投資する場合、お手持り分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資しました。

### <課税上の取り扱い>

- ・分配金には、課税扱いとなる普通分配金と、非課税扱いとなる元本払戻金（特別分配金）があります。分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金（特別分配金）、残りの部分が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収されます。
- ・法人の場合は異なります。

- ※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になる場合があります。
- ※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## お知らせ

### 約款変更

該当事項はありません。

### 運用体制の変更

該当事項はありません。

# マニユライフ・カナダ債券マザーファンド

## 第11期

決算日 2023年8月21日

(計算期間：2022年8月23日～2023年8月21日)

### ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	親投資信託
信託期間	無期限
委託会社等	委託会社：マニユライフ・インベストメント・マネジメント株式会社 運用権限の委託先：マニユライフ・インベストメント・マネジメント・リミテッド
運用方針	①主としてカナダドル建ての公社債および短期金融商品等に投資することにより、安定した金利収入の確保および中長期的な値上り益の獲得をめざして運用を行います。 ・投資にあたっては、カナダドル建ての社債を中心に投資を行います。 ・投資対象の格付は、取得時において投資適格（スタンダード&プアーズ社でBBB-以上、ムーディーズ社でBaa3以上またはそれらと同等）とすることを基本とします。 ②外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ③外貨建資産の運用にあたっては、マニユライフ・インベストメント・マネジメント・リミテッドに運用指図に関する権限（国内の短期金融資産の運用の指図に関する権限を除きます。）の一部を委託します。
主要投資対象	主にカナダドル建ての公社債を投資対象とします。
主な投資制限	①債券への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。



## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数		債券 組入比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率		
7期 (2019年8月20日)	13,481	3.3	13,455	3.0	97.7	3,146
8期 (2020年8月20日)	14,617	8.4	14,371	6.8	97.2	3,306
9期 (2021年8月20日)	15,754	7.8	15,443	7.5	94.3	2,406
10期 (2022年8月22日)	17,596	11.7	17,199	11.4	98.4	2,082
11期 (2023年8月21日)	18,010	2.4	17,638	2.6	97.6	1,819

(注1) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

(注2) 当ファンドの参考指数は、FTSE/TMXカナダ・オール・コーポレート・ボンド・インデックス (円換算ベース/三菱UFJ銀行T T M) です。(2014年4月以降、DEXユニバース・オール・コーポレート・ボンド・インデックスより名称変更となりました。以下、同じ。) 当参考指数は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

## ■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		債券 組入比率
	円	騰落率	円	騰落率	
(期首) 2022年8月22日	17,596	—	17,199	—	98.4
8月末	17,564	△0.2	17,179	△0.1	97.0
9月末	17,319	△1.6	16,956	△1.4	96.3
10月末	17,684	0.5	17,322	0.7	98.2
11月末	17,014	△3.3	16,656	△3.2	97.5
12月末	16,257	△7.6	15,880	△7.7	94.0
2023年1月末	16,640	△5.4	16,237	△5.6	97.0
2月末	16,840	△4.3	16,431	△4.5	97.1
3月末	16,797	△4.5	16,396	△4.7	96.5
4月末	16,910	△3.9	16,507	△4.0	97.0
5月末	17,405	△1.1	17,012	△1.1	98.1
6月末	18,517	5.2	18,116	5.3	98.5
7月末	18,021	2.4	17,624	2.5	95.5
(期末) 2023年8月21日	18,010	2.4	17,638	2.6	97.6

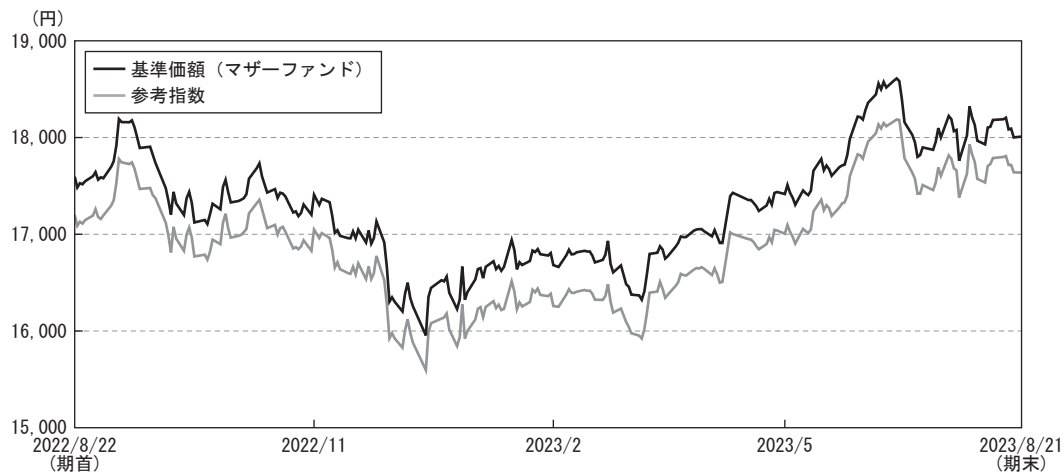
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 基準価額は1万円当たりです。

(注3) 当ファンドの参考指数は、FTSE/TMXカナダ・オール・コーポレート・ボンド・インデックス (円換算ベース/三菱UFJ銀行T T M) です。当参考指数は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

## 運用経過

## ■基準価額等の推移（2022年8月23日から2023年8月21日まで）



期 首：17,596円

期 末：18,010円

騰 落 率： 2.4%

※当ファンドの参考指数は、FTSE/TMXカナダ・オール・コーポレート・ボンド・インデックス（円換算ベース/三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

## ■基準価額の主な変動要因

- ・カナダの国債利回りの上昇がマイナス寄与しました。
- ・安定的な利息収入がプラスに寄与しました。
- ・カナダドルが対円で上昇（円安）したことがプラスに寄与しました。

## ■投資環境

[カナダ債券市況]

カナダ長期国債利回りは、期初に2.9%台で始まった後、期前半にはカナダ銀行（中央銀行）が利上げを一旦停止したことなどから2.7%台まで低下する局面もありましたが、期後半にはインフレ圧力の再度の高まりなどを背景にカナダ銀行（中央銀行）が引上げを再開したこと、米長期金利の上昇などが上昇要因となり3.7%台で期を終えました。カナダ社債は、カナダ長期金利の上昇がマイナス寄与しましたが、安定的な利息収入がプラス寄与し、期を通じて上昇しました（トータル・リターン・ベース）。

[為替市況]

外国為替市場では、カナダドルは対円で上昇（円安）しました。期初に105円台で始まった後、カナダ銀行（中央銀行）の利上げの停止などから95円台まで円高カナダドル安が進行しましたが、再度インフレ圧力の高まりを受けカナダ銀行（中央銀行）が利上げ再開、カナダ長期金利の上昇などを背景に円安カナダドル高が進み、当期末には107円台となりました。

## ■当該投資信託のポートフォリオ

主としてカナダドル建ての公社債を中心に投資を行い、安定した金利収入の確保と中長期的な値上り益の獲得をめざして運用を行いました。

## ■今後の運用方針

市場では、カナダ銀行（中央銀行）の利上げがいつまで継続するのかが注目されています。昨年から継続する利上げ局面は既に終盤にあると考えられ、これまで見られたような利上げが継続する可能性は低いものと考えられます。またこれまでの金融引き締め政策により、景気後退リスクが表面化する可能性もあると考えられます。このような環境下、ポートフォリオの金利感応度を高めることによって、金利低下にも対応できるように備える方針です。

カナダ社債市場については、今後も堅調に推移するとの見通しに変わりはありません。カナダ企業は総じて健全な財務体質を有しており、相対的に高い利回りを求める投資家の需要もカナダ社債市場を後押しすると考えられます。当ファンドでは、安定した利息収入の獲得および中長期的な値上がり益の獲得をめざします。

また、投資対象の格付は、取得時において投資適格（スタンダード&プアーズ社でBBB-以上、ムーディーズ社でBaa3以上またはそれらと同等）とすることを基本とします。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年8月23日～2023年8月21日)		
	金額	比率	
平均基準価額	17,247円	—	期中の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) その他費用	13円	0.073%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他費用
(保管費用)	(12)	(0.071)	・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.002)	・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	13	0.073	

\* 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

\* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

\* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況（2022年8月23日から2023年8月21日まで）  
公社債

			買付額	売付額
			千カナダドル	千カナダドル
外国	カナダ	国債証券	121	—
		地方債証券	43	85
		特殊債証券	77	—
		社債証券 (投資法人債券を含む)	7,517	9,840 (11)

(注1) 金額は受け渡し代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切り捨てております。

(注3) ( ) 内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等（2022年8月23日から2023年8月21日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ■組入資産の明細（2023年8月21日現在）

## (A) 債券種類別開示

## 外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
カ ナ ダ	千カナダドル 18,351	千カナダドル 16,548	千円 1,776,147	% 97.6	% —	% 67.9	% 27.7	% 2.0
合 計	18,351	16,548	1,776,147	97.6	—	67.9	27.7	2.0

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注4) 額面・評価額の単位未満は切り捨てております。

## (B) 個別銘柄開示

## 外国（外貨建）公社債

銘 柄 名	当 期 末					
	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(カナダ)	%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	130	119	12,784	2028/6/1
特殊債券 (除く金融債)	ELECTRICITE DE FRANCE SA	5.993	77	74	7,962	2030/5/23
普通社債券 (含む投資法人債券)	407 INTERNATIONAL INC	4.45	65	60	6,539	2031/8/14
	407 INTERNATIONAL INC	3.65	275	224	24,099	2044/9/8
	ALBERTA POWERLINE LP	4.065	201	168	18,051	2053/12/1
	ALGONQUIN POWER COMPANY	2.85	250	204	21,991	2031/7/15
	ALTAGAS LTD	2.166	270	238	25,644	2027/3/16
	ALTALINK LP	3.99	123	107	11,548	2042/6/30
	ANGLIAN WATER SERVICES F	4.525	123	112	12,029	2032/8/26
	ARC RESOURCES LTD	3.465	90	77	8,296	2031/3/10
	ATCO LTD - CLASS 1	5.5	910	844	90,617	2078/11/1
	ATHABASCA INDIGENOUS MID	6.069	77	77	8,274	2042/2/5
	ATHENE GLOBAL FUNDING	2.1	470	429	46,109	2025/9/24
	AVIVA PLC	4.0	67	58	6,275	2030/10/2
	BANK OF MONTREAL	5.039	72	70	7,562	2028/5/29
	BANK OF MONTREAL	6.534	60	60	6,545	2032/10/27
	BANK OF MONTREAL	7.325	40	39	4,193	2082/11/26
	BANK OF NOVA SCOTIA	5.679	77	75	8,120	2033/8/2
	BELL TELEPHONE CO OF CAN	5.15	38	37	4,029	2028/11/14
	BELL TELEPHONE CO OF CAN	5.85	400	407	43,731	2032/11/10
	BROOKFIELD FIN II INC	5.431	54	51	5,555	2032/12/14
	BROOKFIELD INFRASTRUCTUR	5.616	69	68	7,360	2027/11/14
BROOKFIELD INFRASTRUCTUR	5.71	73	72	7,780	2030/7/27	
BROOKFIELD INFRASTRUCTUR	5.439	50	47	5,141	2034/4/25	
BRUCE POWER LP	4.99	33	31	3,420	2032/12/21	
CAN IMPERIAL BK OF COMME	7.15	30	29	3,121	2082/7/28	

銘	柄	名	当 期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(カナダ)			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
普通社債券 (含む投資法人債券)		CANADIAN NATL RAILWAY CO	4.15	45	42	4,610	2030/5/10
		CANADIAN WESTERN BANK	5.146	49	47	5,102	2027/9/2
		CANADIAN WESTERN BANK	1.818	410	345	37,092	2027/12/16
		CANDIAN CORE REAL EST	3.299	55	49	5,329	2027/3/2
		CAPITAL POWER CORP	3.147	63	50	5,451	2032/10/1
		CARDS II TRUST	5.107	32	30	3,306	2026/1/15
		CENTRAL 1 CREDIT UNION	4.648	43	40	4,339	2028/2/7
		CHIP MORTGAGE TRUST	1.738	30	26	2,896	2025/12/15
		CHOICE PROPERTIES REIT	6.003	37	37	4,010	2032/6/24
		CHOICE PROPERTIES REIT	5.4	56	54	5,803	2033/3/1
		CHOICE PROPERTIES REIT	5.699	46	45	4,857	2034/2/28
		CITIGROUP INC	4.09	232	223	23,992	2025/6/9
		CO-OPERATORS FINANCIAL S	3.327	142	118	12,717	2030/5/13
		COAST CAPITAL SV CRE UN	4.255	63	60	6,478	2025/4/21
		COGECO COMMUNICATIONS IN	2.991	32	26	2,815	2031/9/22
		CROMBIE REAL ESTATE INVE	2.686	70	60	6,479	2028/3/31
		CROMBIE REAL ESTATE INVE	5.244	18	17	1,849	2029/9/28
		CT REAL ESTATE INVESTMEN	3.029	185	159	17,117	2029/2/5
		DAIMLER TRUCKS FI CANADA	5.22	31	30	3,260	2027/9/20
		EAGLE CREDIT CARD TRUST	5.134	31	30	3,265	2028/6/17
		EDMONTON REGIONAL AIRPOR	3.715	74	59	6,351	2051/5/20
		ELLISDON INFRA SNH GP	5.154	136	132	14,205	2057/8/31
		EMERA INC	4.838	60	57	6,148	2030/5/2
		EMPIRE LIFE INSURANCE CO	5.503	227	219	23,570	2033/1/13
		ENBRIDGE INC	6.1	52	53	5,720	2032/11/9
		ENBRIDGE INC	5.375	125	113	12,204	2077/9/27
		ENBRIDGE INC	6.625	150	143	15,375	2078/4/12
		ENBRIDGE INC	5.0	645	527	56,669	2082/1/19
		EQUITABLE BANK	3.362	95	88	9,451	2026/3/2
		FAIRFAX FINANCIAL HOLDIN	4.25	50	46	4,987	2027/12/6
		FEDERATION DES CAISSES D	4.407	116	111	11,956	2027/5/19
		FEDERATION DES CAISSES D	5.475	37	36	3,960	2028/8/16
		FEDERATION DES CAISSES D	5.035	310	297	31,936	2032/8/23
		FIRST NATIONAL FINANCIAL	2.961	250	228	24,574	2025/11/17
		FORTIFIED TRUST	4.419	52	49	5,327	2027/12/23
		GALGARY AIRPORT AUTHORIT	3.554	300	231	24,815	2053/10/7
		GENERAL MOTORS FINANCIAL	5.2	77	74	7,957	2028/2/9
		GIBSON ENERGY INC	5.75	20	19	2,119	2033/7/12
		GIBSON ENERGY INC	6.2	143	141	15,180	2053/7/12
		GLACIER CREDIT CARD TRUS	5.681	47	47	5,052	2028/9/20
	GREAT-WEST LIFE CO INC	2.981	150	103	11,085	2050/7/8	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT	4.071	50	47	5,135	2025/6/16	
	HALIFAX INTL AIRPORT AUT	3.678	19	14	1,548	2051/5/3	
	HEATHROW FUNDING LTD	2.694	142	127	13,634	2027/10/13	

銘	柄	名	当 期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(カナダ)			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
普通社債券 (含む投資法人債券)		HEATHROW FUNDING LTD	3.726	56	47	5,078	2033/4/13
		HYDRO ONE INC	4.91	287	285	30,645	2028/1/27
		IA FINANCIAL CORP INC	3.072	92	84	9,052	2031/9/24
		IA FINANCIAL CORP INC	3.187	67	60	6,543	2032/2/25
		IA FINANCIAL CORP INC	5.685	65	64	6,883	2033/6/20
		IA FINANCIAL CORP INC	6.611	200	191	20,585	2082/6/30
		IGM FINANCIAL INC	5.426	200	198	21,281	2053/5/26
		INTACT FINANCIAL CORP	4.125	130	109	11,798	2081/3/31
		INTACT FINANCIAL CORP	7.338	30	29	3,188	2083/6/30
		INTER PIPELINE LTD	4.232	300	282	30,334	2027/6/1
		INTER PIPELINE LTD	5.76	33	32	3,509	2028/2/17
		INTER PIPELINE LTD	5.71	118	115	12,369	2030/5/29
		INTER PIPELINE LTD	3.983	401	342	36,722	2031/11/25
		INTER PIPELINE LTD	6.38	22	22	2,361	2033/2/17
		INTER PIPELINE LTD	4.637	400	316	33,944	2044/5/30
		IVANHOE CAMBRIDGE II INC	4.994	38	37	3,997	2028/6/2
		KEYERA CORP	5.022	140	131	14,109	2032/3/28
		KINGSTON SOLAR LP	3.571	34	30	3,241	2035/7/31
		MACQUARIE GROUP LTD	2.723	50	42	4,549	2029/8/21
		MANULIFE FINANCIAL CORP	5.409	73	71	7,671	2033/3/10
		MANULIFE FINANCIAL CORP	7.117	20	19	2,068	2082/6/19
		MCAP COMMERCIAL LP	3.743	250	234	25,120	2025/8/25
		NATIONAL BANK OF CANADA	5.426	60	58	6,269	2032/8/16
		NATIONAL GRID ELECTRICIT	5.221	47	45	4,894	2031/9/16
		NORTH WEST REDWATER PART	2.8	375	343	36,817	2027/6/1
		NORTH WEST REDWATER PART	2.8	40	33	3,623	2031/6/1
		NORTHERN COURIER PIPE	3.365	116	99	10,627	2042/6/30
		NOVA SCOTIA POWER INC-UT	4.951	66	63	6,766	2032/11/15
		NOVA SCOTIA POWER INC-UT	5.95	100	103	11,126	2039/7/27
		OMERS REALTY CORP	5.381	56	55	6,001	2028/11/14
		ONTARIO POWER GENERATION	4.248	150	129	13,921	2049/1/18
		PEMBINA PIPELINE CORP	3.62	500	452	48,593	2029/4/3
		PENSKE TRUCK LEASING CAN	5.44	28	27	2,971	2025/12/8
		PRIMARIS REAL ESTATE INV	4.727	64	59	6,437	2027/3/30
		PRIMARIS REAL ESTATE INV	5.934	41	39	4,266	2028/3/29
		PRIME STRUCTURED MTGE TR	2.0	579	511	54,846	2026/10/15
		PROLOGIS LP	5.25	142	138	14,853	2031/1/15
		RIOCAN REAL ESTATE INVST	5.611	58	56	6,071	2027/10/6
		RIOCAN REAL ESTATE INVST	4.628	70	64	6,928	2029/5/1
		ROGERS COMMUNICATIONS IN	3.75	28	25	2,725	2029/4/15
	ROGERS COMMUNICATIONS IN	4.25	292	259	27,865	2032/4/15	
	ROGERS COMMUNICATIONS IN	5.25	620	546	58,661	2052/4/15	
	ROYAL BANK OF CANADA	5.01	47	45	4,832	2033/2/1	
	SAGEN MI CANADA INC	5.909	44	42	4,566	2028/5/19	

銘	柄	名	当 期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(カナダ)			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
普通社債券 (含む投資法人債券)	SAGEN MI CANADA INC		4.95	102	83	9,002	2081/3/24
	SIENNA SENIOR LIVING INC		2.82	100	87	9,405	2027/3/31
	SMARTCENTRES REAL ESTATE		5.354	55	52	5,673	2028/5/29
	SMARTCENTRES REAL ESTATE		3.526	400	343	36,847	2029/12/20
	SUN LIFE FINANCIAL INC		2.8	50	43	4,635	2033/11/21
	SUN LIFE FINANCIAL INC		4.78	77	73	7,850	2034/8/10
	TELUS CORP		5.15	370	334	35,882	2043/11/26
	TORONTO-DOMINION BANK		4.477	178	170	18,322	2028/1/18
	TORONTO-DOMINION BANK		7.283	81	79	8,488	2082/10/31
	TRANSCANADA PIPELINES LT		5.277	82	80	8,615	2030/7/15
	TRANSCANADA PIPELINES LT		4.34	350	273	29,406	2049/10/15
	TRANSCANADA TRUST		4.65	305	268	28,798	2077/5/18
	TRANSCANADA TRUST		4.2	214	165	17,795	2081/3/4
	TRISUMMIT UTILITIES INC		5.02	36	34	3,739	2030/1/11
	UNION GAS LTD		3.59	200	157	16,898	2047/11/22
	VW CREDIT CANADA INC		5.86	17	17	1,830	2027/11/15
	WSP GLOBAL INC		2.408	82	71	7,692	2028/4/19
合 計			—	—	—	1,776,147	—

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨てております。

## ■有価証券の貸付及び借入の状況 (2023年8月21日現在)

該当事項はありません。

## ■投資信託財産の構成

(2023年8月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	1,776,147	97.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	54,566	3.0
投 資 信 託 財 産 総 額	1,830,713	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨てております。

(注2) 当期末における外貨建純資産 (1,795,090千円) の投資信託財産総額 (1,830,713千円) に対する比率は98.1%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1カナダドル=107.33円です。



## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年8月21日
(A) 資 産	1,830,713,264円
コール・ローン等	32,449,960
公社債(評価額)	1,776,147,937
未 収 利 息	21,806,126
前 払 費 用	309,241
(B) 負 債	10,976,210
未 払 金	5,044,510
未 払 解 約 金	5,929,319
そ の 他 未 払 費 用	2,381
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,819,737,054
元 本	1,010,405,226
次 期 繰 越 損 益 金	809,331,828
(D) 受 益 権 総 口 数	1,010,405,226口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,010円

(注1) 当親ファンドの期首元本額は1,183,382,203円、期中追加設定元本額は56,072,320円、期中一部解約元本額は229,049,297円です。

(注2) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は以下の通りです。  
マニユライフ・カナダ債券ファンド

1,010,405,226円

(注3) 1口当たり純資産額は1.8010円です。

## ■損益の状況

項 目	当 期 自2022年8月23日 至2023年8月21日
(A) 配 当 等 収 益	90,205,999円
受 取 利 息	85,483,737
そ の 他 収 益 金	4,722,262
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 45,542,074
売 買 益	36,585,706
売 買 損	△ 82,127,780
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,403,928
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	43,259,997
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	898,884,601
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	40,200,049
(G) 解 約 差 損 益 金	△173,012,819
(H) 計 (D+E+F+G)	809,331,828
次 期 繰 越 損 益 金(H)	809,331,828

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

※当ファンドは監査対象ではありません。

## お知らせ

## ◆約款変更

該当事項はありません。

## ◆運用体制の変更

該当事項はありません。